

**Белорусский государственный университет
Экономический факультет
Кафедра аналитической экономики и эконометрики**

Реферат к дипломной работе

**«Формирование портфеля ценных бумаг на основе
имитационного моделирования»**

Вечорко Алеся Александровна

Научный руководитесь: к.э.н, доцент А.Б.Гедранович

2015г.

РЕФЕРАТ

Работа содержит: 67 страниц, 5 рисунков, 9 таблиц, 8 формул, 57 источников, 6 приложений.

Ключевые слова: ЦЕННЫЕ БУМАГИ, АКЦИЯ, ФОНДОВЫЙ РЫНОК, ПОРТФЕЛЬ ЦЕННЫХ БУМАГ, ДИВЕРСИФИКАЦИЯ, РИСК, ДОХОДНОСТЬ, МОДЕЛЬ ШАРПА, МОДЕЛЬ МАРКОВИЦА, ЭФФЕКТИВНАЯ ГРАНИЦА.

Целью работы является нахождение наилучшего портфеля ценных бумаг для инвестора на основе модели Марковица с помощью имитационного моделирования.

Объектом исследования являются акции крупнейший мировых компаний.

Предметом исследования является – методы формирования портфеля ценных бумаг исследуемых компаний.

Методы исследования: научный синтез, имитационное моделирование, системный метод, графический метод отображения информации.

В процессе работы были получены следующие результаты: уточнены методы формирования портфелей ценных бумаг на основе моделей Марковица и Шарпа; созданы несколько различных инвестиционных портфелей на основе акций нескольких компаний.

Новизна полученных результатов заключается в методике формирования инвестиционных портфелей, позволяющей выбрать наилучший портфель среди созданных портфелей ценных бумаг.

Степень внедрения и рекомендации по внедрению полученных результатов: использование полученных в работе результатов будет способствовать при выборе инвестора наиболее оптимальный портфель ценных бумаг.

Автор работы подтверждает, что работа выполнена самостоятельно и приведенный в ней расчетно-аналитический материал правильно и объективно отражает состояние исследуемого процесса, а все заимствованные из литературных и других источников теоретические, методологические положения и концепции сопровождаются ссылками на их авторов.

РЕФЕРАТ

Праца змяшчае: 67 старонак, 5 малюнкаў, 9 табліц, 8 формул, 57 крыніц, 6 дадаткаў.

Ключавыя словы: КАШТОЎНЫЕ ПАПЕРЫ, АКЦЫЯ, ФОНДАВЫ РЫНАК, ПАРТФЕЛЬ КАШТОЎНЫХ ПАПЕР, ДЫВЕРСИФІКАЦЫЯ, РЫЗЫКА, ПРЫБЫТКОВАСЦЬ, МАДЭЛЬ ШАРПА, МАДЭЛЬ МАРКАВІЦА, ЭФЕКТЫЎНАЯ МЯЖА

Мэтай дадзенай працы з'яўляецца знаходжанне найлепшага партфеля каштоўных паперт для фундатара на базе мадэлі Маркавіца з дапамогай імітацыйнага мадэлявання.

Аб'ектам даследавання з'яўляюцца акцыі сусветных кампаній.

Прадмет даследавання з'яўляюцца метады фармавання партфеля каштоўных папер кампаній даследавання.

Метады даследавання: навуковы сінтэз, статыстычны аналіз, сістэмны метады, графічны метады адлюстравання інфармацыі.

Падчас работы былі атрыманы наступныя вынікі: удакладнены метады фармавання партфеляў каштоўных папер на грунце мадэляў Маркаўца і Шарпа; створаны некалькі розных інвестыцыйных партфеляў на базе акцый кампаній.

Навізна атрыманых вынікаў складаецца ў методыцы фармавання інвестыцыйных партфеляў, якая дазваляе выбраць найлепшы партфель сярод створаных партфеляў каштоўных папер.

Ступень ўкаранення і рэкамендацыі па ўкараненні атрыманых вынікаў: выкарыстанне атрыманых у працы вынікаў будзе спрыяць пры выбары фундатара найболей аптымальнага партфеля каштоўных папер.

Аўтар працы пацвярджае, што праца выканана самастойна і прыведзены ў ёй разлікова-аналітычны матэрыял правільна і аб'ектыўна адлюстроўвае стан доследнага працэсу, а ўсе запазычаныя з літаратурных і іншых крыніц тэарэтычныя, метадалагічныя становішча і канцэпцыі суправаджаюцца спасылкамі на іх аўтараў.

ANNOTATION

The work contains 67 pages, 5 figures, 9 tables, 8 formula, 57 sources, 6 applications.

Keywords: SECURITIES, SHARE, STOCK MARKET, THE SECURITIES PORTFOLIO, DIVERSIFICATION, RISK, YIELD, SHARP MODEL, MARKOWITZ MODEL, THE EFFICIENT FRONTIER.

The purpose of this work is to find the best of the securities portfolio for the investor based on the Markowitz model with the help of simulation.

The object of the research are the largest shares of global companies.

The subject of the research - the methods of formation of the securities portfolio investigated companies.

Methods: scientific synthesis, simulation, systematic method, graphical method for displaying information.

The following results were obtained: refined methods of formation of portfolios based on models of Markowitz and Sharpe; we created a number of different investment portfolios based on shares of several companies.

The novelty of the results is the method of formation of investment portfolios lets you choose among the best portfolio to create a portfolio of securities.

The degree of implementation and recommendations for the implementation of the results: the use of obtained results will contribute to the investor in selecting the optimal portfolio.

The author of the work confirms that the work is done independently and powered her settlement and analytical materials correctly and objectively reflects the state of the test process, and all borrowed from literature and other sources of theoretical, methodological terms and concepts are accompanied by references to their authors
